

BME CLEARING

Requerimientos de capital por las exposiciones frente a BME CLEARING a raíz de las contribuciones a la garantía colectiva de acuerdo a la metodología / Capital requirements for default fund exposures to BME CLEARING "Standardized Approach for Counterparty Credit Risk (SA-CCR)"

31/03/2025

Resumen de estadísticas clave / Key Summary Statistics	Derivados Financieros / Financial Derivatives	Energía / Energy	Repo / Fixed Income	IRS	Renta Variable / Cash Equities
Unidad / Unit	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000
N: Número de miembros compensadores / Number of clearing members	28	7	24	8	23
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	3,400	350	350	50	1,200
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	2,050	250	250	50	750
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	5,450	600	600	100	1,950
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	688,350	68,900	68,900	5,100	253,100
K _{CCP} : Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	7,116	265	0	3	0
C-factor = max(K _{CCP} *(DF _i / (DF _{CCP} + DF _{CM})); 8% * 2% * DF _i)	1.03%	0.38%	0.16%	0.16%	0.16%
KCMi if DFi = 1.000	10.26	3.82	1.60	1.60	1.60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)	2,393.24	136.32	196.93	5.77	394.44

*IM : Garantías por posición y garantías individuales / Initial Margin and Individual Funds